



## Düsseldorf

16. März 2010

09:15 – 17:15 Uhr

Hotel Intercontinental Düsseldorf

Königsallee 59

40215 Düsseldorf

[duesseldorf.intercontinental.com](http://duesseldorf.intercontinental.com)

## München

15. Juni 2010

09:15 – 17:15 Uhr

The Charles Hotel

Sophienstraße 28

80333 München

[charleshotel.de](http://charleshotel.de)

Bild: Stockphoto



portfolio institutionell Expertenseminare werden unter redaktioneller Leitung des portfolio Verlages veranstaltet.

portfolio Verlagsgesellschaft mbH  
Kleine Hochstraße 9-11  
60313 Frankfurt am Main  
Tel.: +49 (0)69 8570 8153  
[portfolio-institutionell.de](http://portfolio-institutionell.de)

Wie gehen Banken und Sparkassen mit der aktuellen Zinssituation um? Wie wird sinnvolle Gesamtbank- und Risiko-steuerung betrieben? Und wie managt und integriert man hierbei die Eigenanlagen in erfolgreicher Weise?

## Fokus Banken-Treasury

Das Seminar richtet sich an Vorstände, Leiter Treasury, Depot-A-Manager, Mitarbeiter im Banken-Treasury, im Controlling und in der Gesamtbank-steuerung von Banken und Sparkassen. Die Teilnehmerzahl ist begrenzt.

expertenseminar  
portfolio institutionell

## Fokus Banken-Treasury

Expertenseminar

Impulse für Gesamtbanksteuerung, Risikosteuerung sowie Integration und Management der Eigenanlagen



Kompakt, voller Inhalt, aktive Diskussion, 100 % relevant.

## Kompakte Inhalte: das Programm

### 09:15 Eröffnung – Begrüßung, Tagesablauf und Hinweise

Armin Forstner, Head of Operations, portfolio Verlag  
Martin Aehling, freier Journalist und Berater

### 09:30 Neuere Entwicklungen in der bankaufsichtlichen Praxis

Referent Düsseldorf: Dr. Rainer Janlewing, Referat Bankgeschäftliche Prüfungen, Deutsche Bundesbank, HV Düsseldorf  
Referent München: Josef Stöttner, Bundesbankdirektor, Regionalbereich Banken und Finanzaufsicht, HV München  
- Aktuelle Entwicklungen und Diskussionen  
- Gesamtbanksteuerung im Fokus der Aufsicht  
- Neue Anforderungen der MaRisk im Bereich des Ertragskonzentrationsrisikos

### 10:15 Steuerung des Strukturbeitrags im Spannungsfeld von Kapitalmarktrisiken und Aufsichtsrecht

Dr. Wilhelm Menninghaus, Partner, ZEB  
Thomas Dinkela, Leiter Controlling, Sparkasse Münsterland-Ost  
- Identifikation des „Benchmark“-Hebels für das Geschäftsmodell: Wie viel Transformation ist gesund und notwendig?  
- Umgang mit dem „Ausreißeransatz“ der MaRisk  
- Ergebnisoptimierung in den Schnittstellen Vertrieb und Treasury: effiziente Bewirtschaftung des Kundengeschäfts  
- Strategische Optionen und relevante Handlungsagenda in der aktuellen Zinsphase

11:15 Kaffeepause

### 11:45 Die Risikosteuerung im Treasury einer Sparkasse

Dr. Bernd Hochberger, Leiter Treasury, Generalbevollmächtigter, Stadtparkasse München  
- Rolle des Treasury in der Stadtparkasse München  
- Duale Risikosteuerung im Treasury  
- Instrumentenbaukasten der Risikosteuerung – ausgewählte Praxisbeispiele

12:30 Mittagspause

### 13:15 Asset-Allokation im Wandel der Zeit

Dominik Schlarmann, Leiter Treasury, Sparda-Bank West eG  
- Asset-Allokation auf Gesamtbankebene  
- Kapitalmarktorientierte versus konjunkturphasenabhängige Investitionsmodelle  
- Overlay-Management: Instrument zur taktischen Asset-Allokation

### 14:00 Diskussionsrunde

Moderation München: Joachim Fröhlich, Senior Consultant, Faros Consulting  
Moderation Düsseldorf: Hendryk Braun, Geschäftsführender Partner, 1 Plus i

### 14:45 Risk@Work Overlay – Bindeglied zwischen Asset-Allokation, Risikokapitalbudget und Performance-Anspruch (Sponsorenbeitrag)

Dr. Dirk Rogowski, Geschäftsleiter Deutschland, Pall Mall Investment Management  
- Asset-Allokation ohne Normalverteilungsfiktion, aber mit Integration illiquider Asset-Klassen  
- Atmende Portfoliorisiken in Abhängigkeit vom Risikokapitalbudget  
- Readjustierung des Portfolios als Performance-Treiber

15:15 Kaffeepause

### 15:45 Overlay-Management in der Praxis einer Sparkasse

Peter Smolinski, Leiter Treasury, Sparkasse Hildesheim  
- Von der Grundüberlegung zum fertigen Portfolio  
- Umsetzung in der Praxis  
- Einbindung in die Gesamtallokation und Nutzung für taktische Asset Allocation

### 16:30 MaRisk-konformes ertragsorientiertes Liquiditätsrisikomanagement

Prof. Stefan Zeranski, Institut für Recht, Finanzen und Steuern, Ostfalia-Hochschule für angewandte Wissenschaften  
- Betriebswirtschaftlicher und bankaufsichtlicher Überblick zum Liquiditätsrisiko inklusive Stresstests  
- Pragmatischer Ansatz für die kurzfristige Liquiditätssteuerung  
- Pragmatischer Ansatz für die strukturelle Liquiditätssteuerung

17:15 Seminarende und Verabschiedung

## Führende Köpfe: die Referenten

### Martin Aehling, freier Journalist und Berater

Martin Aehling ist seit März 2008 freier Journalist sowie Redakteur und Berater der portfolio Verlagsgesellschaft. Von Februar 2006 bis Februar 2008 war er Chefredakteur von portfolio institutionell.

### Hendryk Braun, Geschäftsführender Partner, 1 Plus i

Hendryk Braun ist Geschäftsführender Partner bei 1 Plus i. Er unterstützt Kreditinstitute bei der qualitativen und quantitativen Vorbereitung auf die Implementierung von internen Marktrisikomodellen und Handelssystemen. Vorhergehende Stationen waren die Berliner Volksbank und Roland Eller Consulting. [Seminar Düsseldorf]

### Thomas Dinkela, Leiter Controlling, Sparkasse Münsterland Ost

Thomas Dinkela ist seit 2001 Leiter Controlling und stellvertretender Bereichsleiter Unternehmenssteuerung in der Sparkasse Münsterland Ost. Zuvor war er Referent in der Unternehmensberatung für Sparkassen im SVWL und als Controller auch in der Sparkasse Warendorf tätig. Er ist zudem Dozent an der Sparkassenakademie.

### Joachim Fröhlich, Senior Consultant, Faros Consulting

Joachim Fröhlich ist Senior Investment Consultant bei Faros Consulting und berät institutionelle Investoren im Bereich Investmentprozess Lösungen etc. Vorher war er als Leiter Kapitalmarkt- und Zinsbuchsteuerung für die Wüstenrot-Bank und die Wüstenrot-Bausparkasse tätig. [Seminar München]

### Dr. Bernd Hochberger, Leiter Treasury, Stadtparkasse München

Dr. Bernd Hochberger leitet bei der Stadtparkasse München den Unternehmensbereich Treasury, der für die Risikosteuerung, das Depot A und den Handel zuständig ist. In der Stadtparkasse München war er vorher für die strategische Planung verantwortlich. Davor war er bei Roland Berger im Bereich Financial Services tätig.

### Dr. Rainer Janlewing, stv. Leiter Referat Bankgeschäftliche Prüfungen, Deutsche Bundesbank

Dr. Rainer Janlewing ist stv. Leiter des Referats Bankgeschäftliche Prüfungen im Regionalbereich Banken und Finanzaufsicht der Deutschen Bundesbank, Hauptverwaltung Düsseldorf. Dort leitet er größere MaRisk-Prüfungen sowie Zulassungsprüfungen von internen Risikomodellen. [Seminar Düsseldorf]

### Dr. Wilhelm Menninghaus, Partner, zeb

Dr. Wilhelm Menninghaus ist als Partner bei zeb/rolfes.schierenbeck.associates im Competence-Center für die Themen Marktpreisrisiko-Steuerung und Treasury-Management verantwortlich. Seine Schwerpunkte sind ALM, Treasury-Management sowie Risk-Management und Risikomessung.

### Dr. Dirk Rogowski, Geschäftsleiter, Pall Mall Investment Management Deutschland (Sponsor)

Dr. Dirk Rogowski ist Geschäftsleiter Deutschland bei Pall Mall Investment Management. Vorhergehende berufliche Stationen waren Boston Consulting Group, Berliner Volksbank, DG-Bank, Hamburger Sparkasse und HSH Nordbank.

### Dominik Schlarmann, Leiter Treasury, Sparda-Bank West eG

Dominik Schlarmann ist seit 2007 Leiter Treasury der Sparda-Bank West eG in Düsseldorf und Sprecher des Ausschusses zum strategischen Management. Zuvor war er als Berater Gesamtbanksteuerung von 2001 bis 2007 bei der WGZ-Bank tätig.

### Peter Smolinski, Leiter Treasury, Sparkasse Hildesheim

Peter Smolinski ist seit 1998 Leiter Treasury der Sparkasse Hildesheim. Zu seinen Aufgaben gehören neben dem klassischen Treasury mit Asset-Allokation und Zinsbuchsteuerung auch die individuelle Vermögensverwaltung und der Bereich Zins- und Währungsmanagement für Firmenkunden.

### Josef Stöttner, Bundesbankdirektor, Deutsche Bundesbank

Josef Stöttner ist Bundesbankdirektor, Regionalbereich Banken und Finanzaufsicht, der Deutschen Bundesbank, Hauptverwaltung München. Seit 1994 ist er in der Bankenaufsicht in verschiedenen Funktionen und im Controlling der Deutschen Bundesbank tätig. [Seminar München]

### Prof. Stefan Zeranski, Institut für Recht, Finanzen und Steuern, Ostfalia-Hochschule für angew. Wissenschaften

Stefan Zeranski ist Professor der BWL für Finanzdienstleistungen und Finanzmanagement am Institut für Recht, Finanzen und Steuern der Ostfalia-Hochschule für angewandte Wissenschaften.

Mit freundlicher Unterstützung von



expertenseminar  
portfolio institutionell

